

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2017

O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações contidas nesse relatório foram extraídas dos relatórios de risco já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

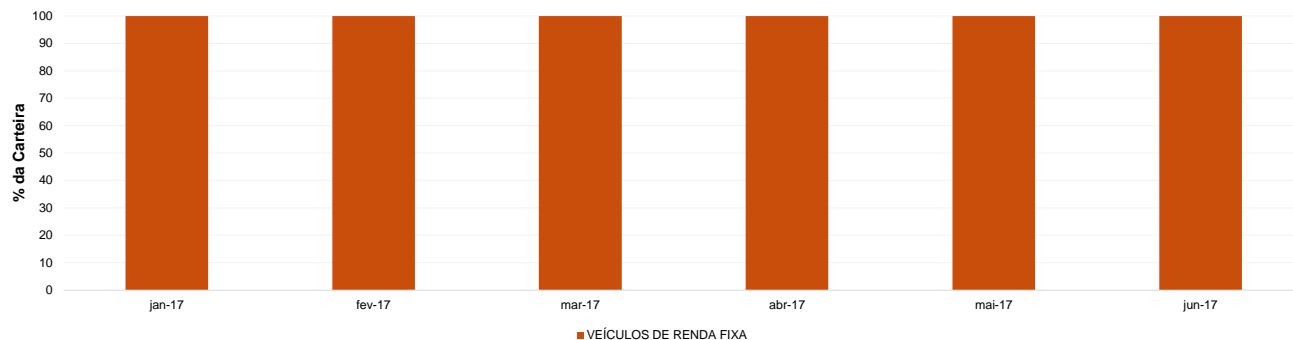
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	7.956.549,00	100,00%			-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,12%	1,25%	3,32%	3,32%	7,44%	22,01%	38,63%	
Renda Fixa CDI	7.956.549,00	100,00%			0,02%	0,83%	2,70%	5,83%	5,83%	13,30%	-	-
BRADESCO FI RF REF DI PREMIUM	7.956.549,00	100,00%	BRADESCO	0,09%	0,02%	0,83%	2,70%	5,83%	5,83%	13,30%	29,29%	44,86%
Benchmark:	CDI				0,81%	2,55%	5,66%	5,66%	12,87%	28,77%	43,97%	
Total	7.956.549,00	100,00%			0,02%	0,83%	2,70%	5,83%	5,83%	13,30%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,12%	1,25%	3,32%	3,32%	7,44%	22,01%	38,63%	



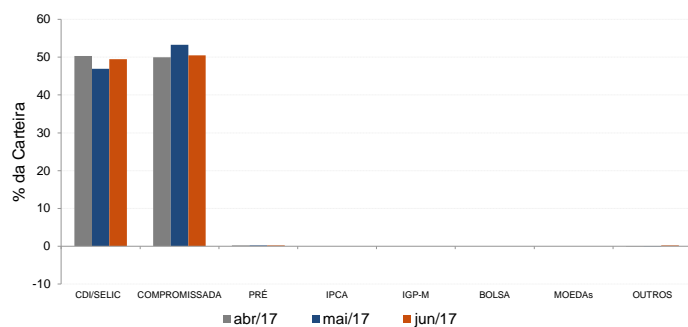
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

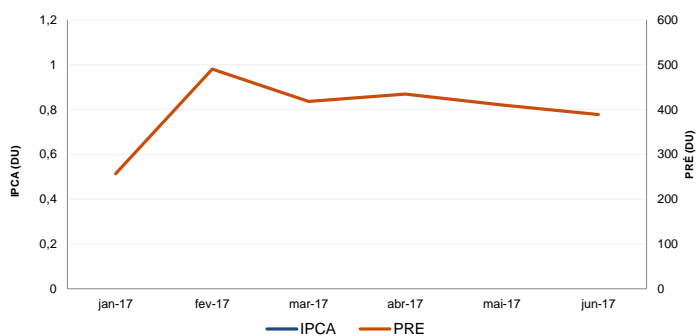
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

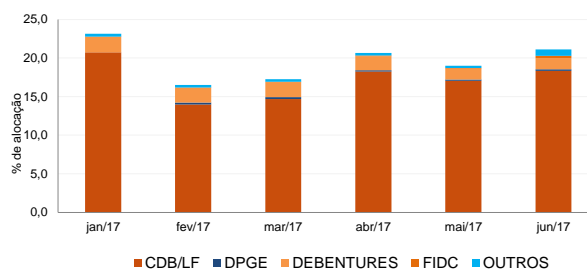
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BRADESCO SA	1.042,01	13,14	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO BRASIL SA	173,25	2,18	AA+ (bra)	Aa1.br	
ITAU UNIBANCO SA	146,96	1,85	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
NCF PARTICIPACOES SA	63,84	0,81	AA+ (bra)		
BCO VOLKSWAGEN SA	33,60	0,42			brAA-
BV LEASING ARREND MERCANTIL SA	29,57	0,37			brAA+
BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	24,59	0,31	AAA (bra)		
TERMOPERNAMBUCO SA	20,98	0,26			
BCO SAFRA SA	20,75	0,26		Aa1.br	brAA-
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	16,45	0,21		Aaa.br	brAA-

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Rating no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de rating encontrada.									

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos investidos.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
LCI CDI	14-ago-19	25.788	0,33%	CDI	ITAU UNIBANCO SA	14-jun-17	102,10%	brAA-	S&P	BRANCO FI RF REF DI PREMIUM
LF CDI	14-jun-19	2.164	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	14-jun-17	104,00%	brAA-	S&P	BRANCO FI RF REF DI PREMIUM
LF CDI	17-jun-19	7.932	0,10%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	16-jun-17	103,80%	brAA-	S&P	BRANCO FI RF REF DI PREMIUM
LF CDI	15-jul-19	51.575	0,65%	CDI	ITAU UNIBANCO SA	14-jun-17	102,05%	brAA-	S&P	BRANCO FI RF REF DI PREMIUM